



Profuturo®

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

FONDO PROFUTURO SB2, S.A. DE C.V., SIEFORE, SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO

TIPO DE SIEFORE: Básica 1 () Básica 2 (x) Básica 3 () Básica 4 () Básica de Pensiones () Corto Plazo () Largo Plazo () Previsión Social ()

ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA AL 30 DE SEPTIEMBRE DE:

(Cifras en miles de pesos)

	2017	2016		2017	2016
ACTIVO			PASIVO		
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	2,685,474	2,469,814	Divisas por entregar	-	275,505
Bancos monedas extranjeras	437,479	1,239,607	Acreedores	43,115	642,642
	<u>3,122,953</u>	<u>3,709,421</u>	Provisiones para gastos	13,798	11,764
RESERVADOS			TOTAL PASIVO	<u>56,912</u>	<u>929,911</u>
Depósitos reservados al pago de compromisos futuros en MN	-	583,624			
		<u>583,624</u>	CAPITAL CONTABLE		
INVERSIONES			CAPITAL		
Inversión en valores de renta variable	25,909,867	15,523,737	Capital contribuido	78,828,449	61,928,634
Plus (Minus) valías en Valores de Renta Variable	7,329,466	5,779,935	Capital social pagado	18,164,746	16,054,566
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y USD	52,350,650	33,802,693	Prima en venta de acciones	60,663,703	45,874,068
Plus (Minus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa real denominados en pesos y USD	6,108,508	4,210,645	Capital ganado	<u>70,761,851</u>	<u>61,448,349</u>
Inversión en instrumentos de Deuda Nacional de Tasa Nominal Denominados en Pesos	56,880,071	61,517,733	Resultados de ejercicios anteriores	64,259,864	58,356,021
Plus (Minus) valía en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal denominados en pesos	-95,186	-164,568	Resultado del ejercicio	6,501,987	3,092,328
Inversión en instrumentos de deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	286,877	480,698	Otros Resultados Integrales		
Plus (Minus) valía en instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	104,182	202,489	Plus (Minus) valías	13,740,549	10,909,938
Plus (Minus) valía en instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	1,089,207	515,478			
Inversión en Fibras	14,402	15,015	TOTAL CAPITAL CONTABLE	<u>163,330,848</u>	<u>134,286,921</u>
Plus (Minus) valía en Inversión en Fibras	1,745,503	1,151,509			
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	-112,625	-125,842	TOTAL PASIVO Y CAPITAL	<u>163,387,761</u>	<u>135,216,833</u>
Inversión en Valores Extranjeros de Deuda	269,448	690,208			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	5,942,443	1,991,396			
Inversión en Títulos Fiduciarios	206,344	225,393			
Plus (minus) valía en Títulos Fiduciarios	4,761,608	3,275,498			
	1,041,458	766,970			
	<u>158,979,221</u>	<u>129,858,887</u>			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	-	92,540			
Dividendos o derechos por cobrar	46,187	3,083			
Intereses devengados sobre valores	1,239,400	969,279			
	<u>1,285,587</u>	<u>1,064,901</u>			
TOTAL ACTIVO	<u>163,387,761</u>	<u>135,216,833</u>			

CUENTAS DE ORDEN

Valores entregados en custodia	158,709,773	129,168,679	Capital social autorizado	1,000,000,100	1,000,000,100
Garantías Recibidas de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	3,089	-	Acciones emitidas	1,000,000,100,000	1,000,000,100,000
Bancos divisivas en moneda extranjera	24,220	64,132	Acciones en circulación posición propia	134,581,018	119,447,762
Dólares americanos	23,578	63,458	Acciones de Siefores, Posición de Terceros	1	1
Otras Divisas	642	675	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	18,030,164,777	15,935,118,363
Dólar canadiense	642	675			
Divisas por entregar	-	14,218			
Dólares americanos	-	14,218			
Compromisos futuros por la adquisición de títulos fiduciarios	5,797,624	3,411,546			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Larga	6,475,816	7,431,254			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	3,501,602	-			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	37,698	19,655			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Extranjera	1,775,942	5,021,751			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	1,159,632	2,389,848			
Contratos de Opciones sobre Renta Variable Nacional	743	-			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición Corta	24,908,991	21,876,610			
Contratos Futuros sobre Renta Fija (Bonos)	4,664,276	6,339,012			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	11,805,201	6,710,566			
Contratos Futuros sobre Euros	5,206,761	5,447,277			
Contratos Futuros sobre Nenes	1,762,444	2,087,041			
Contratos Futuros sobre Otras Divisas	1,470,309	1,292,715			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$ 13,740,549	\$ 10,909,938
Un valor de los activos netos de:	\$ 163,330,848	\$ 134,286,921
El precio de la acción de:	\$ 8.991640	\$ 8.364407

MARTHA BARRERA FERNÁNDEZ
Contador General SIEFORE

Declaro bajo protesta de decir verdad que los datos contenidos son auténticos y veraces

ARTURO GARCÍA RODRÍGUEZ
Director General

Declaro bajo protesta de decir verdad que los datos contenidos son auténticos y veraces

Los presentes estados financieros han sido formulados de acuerdo a las reglas de agrupación de cuentas establecidas por la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro y bajo la estricta responsabilidad de los funcionarios que suscriben
Los presentes estados financieros fueron aprobados por el consejo de administración de fecha 24 de octubre de 2017

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

FONDO PROFUTURO SB2, S.A. DE C.V., SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO

TIPO DE SIEFORE: Básica 1 () Básica 2 (x) Básica 3 () Básica 4 () Básica de Pensiones () Corto Plazo () Largo Plazo () Previsión Social ()

ESTADO DE RESULTADOS INTEGRAL

(Cifras en miles de pesos)

Por los periodos al 30 de Septiembre de:

	2017	2016
Ingresos por la venta de valores	59,301,496	33,607,096
Intereses, dividendos, premios y derechos	4,519,191	3,850,414
Resultado cambiario / Otros productos	-87,049	177,744
Resultados por Intermediación con Instrumentos Financieros Derivados	1,802,762	-1,069,910
Ingresos Netos	<u>65,536,400</u>	<u>36,565,344</u>
Costo de ventas de valores	57,836,935	32,437,844
Gastos generales	18,132	18,812
Comisiones sobre saldos	1,170,346	1,016,360
Egresos netos	<u>59,034,413</u>	<u>33,473,015</u>
Utilidad de operación	<u>6,501,987</u>	<u>3,092,328</u>
Otros Resultados Integrales	5,032,406	4,630,133
Plus (Minus) Valías		
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	<u>11,534,393</u>	<u>7,722,461</u>

MARTHA BARRERA FERNÁNDEZ
Contador General SIEFORE

Declaro bajo protesta de decir verdad que los datos contenidos son auténticos y veraces

ARTURO GARCÍA RODRÍGUEZ
Director General

Declaro bajo protesta de decir verdad que los datos contenidos son auténticos y veraces

El presente estado financiero se formuló de conformidad con las reglas de agrupación de cuentas establecidas por la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro y bajo la estricta responsabilidad de los funcionarios que suscriben.
Los presentes estados financieros fueron aprobados por el consejo de administración de fecha 24 de octubre de 2017